



【2024-06-20】

今日美元/人民币中间价报 7.1192，较上一个交易日上调 33bp，各期限收盘价较上一交易日略微下行。

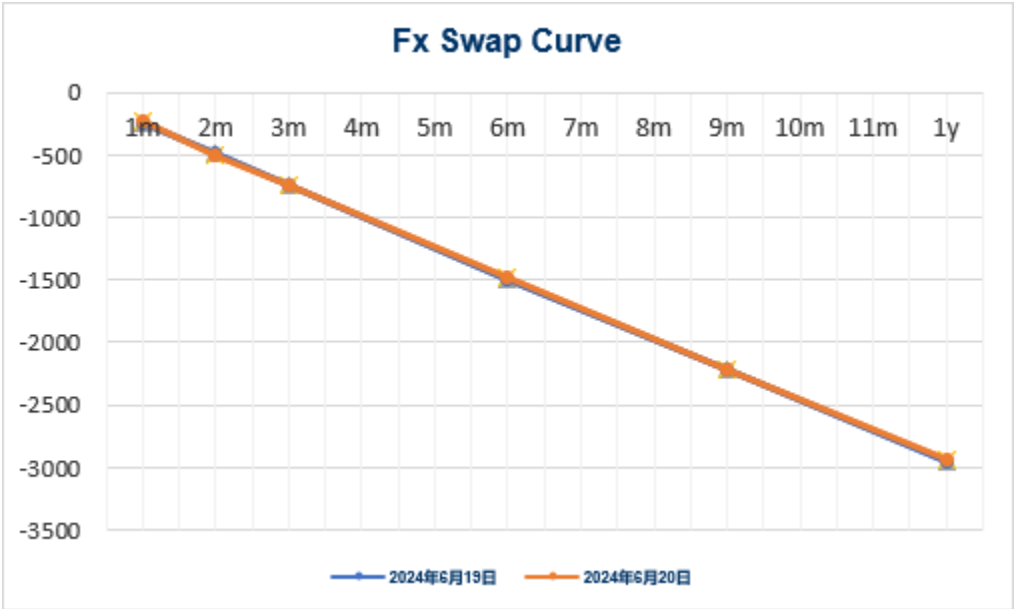
ON 成交在-7.54~-7.3 之间；TN 从-22.5 一路买到-20，尾盘收在-20；SN 在-7.6~-7.53 之间反复成交，尾盘收在-7.53。1W 成交在-53.8~-53.72 之间，尾盘收在-53.72。1S 成交在-232.8~-232.6 之间；2S 成交在-498.7~-497 附近；3S 成交在-735.8~-734 之间。

中长期限，6S 成交在-1488 附近；9S 成交在-2225 附近；1Y 从-2947 给到-2950，后又买回-2945、-2943。

Spread 方面，6\*9S 成交在-742，6\*12S 成交在-1462，9\*12S 成交在-720、-721。

| Tenor                   | Days | Swap (Mid) | Forward(Mid) | ΔSWAP PIPS |
|-------------------------|------|------------|--------------|------------|
| 1W                      | 7    | -54        | 7.2551       | -0.62      |
| 2W                      | 14   | -108       | 7.2497       | 1          |
| 1M                      | 30   | -233       | 7.2373       | 8.35       |
| 2M                      | 63   | -498       | 7.2108       | -16        |
| 3M                      | 92   | -734       | 7.1871       | 13.9       |
| 6M                      | 183  | -1483      | 7.1122       | 15         |
| 9M                      | 273  | -2221      | 7.0384       | -1         |
| 1Y                      | 365  | -2945      | 6.9660       | 5          |
| 18M                     | 548  | -4115      | 6.8490       | -40        |
| 2Y                      | 730  | -4995      | 6.7610       | -70        |
| 3Y                      | 1095 | -6025      | 6.6580       | -230       |
| CNY CENTRAL PARITY RATE |      |            | 7.1192       |            |
| CLOSING SPOT RATE       |      |            | 7.2605       |            |

| USD/CNY Spread Ref. |      |        |         |         |         |
|---------------------|------|--------|---------|---------|---------|
|                     | 2M   | 3M     | 6M      | 9M      | 1Y      |
| 1M                  | -265 | -501.5 | -1250.5 | -1988.5 | -2712.5 |
| 2M                  |      | -236.5 | -985.5  | -1723.5 | -2447.5 |
| 3M                  |      |        | -749    | -1487   | -2211   |
| 6M                  |      |        |         | -738    | -1462   |
| 9M                  |      |        |         |         | -724    |



联系人：Rafael Wang  
邮箱：rafael.wang@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日评及更多资讯



免责声明:

以上所含及附加的所有信息（以下简称“信息”）仅用以提供信息，且为保密的和／或者专用的信息，其知识产权属于上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”）或第三方，“信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、投资或任何交易策略相关的报价、出价、建议或请求。“信息”不可作为决策依据，也不保证其完整性、时效性或准确性等要求，且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN